
尊敬的评委您好

这是外部代码工具箱、代码文件（.m）和数据包文件（.mat/.xlsx）的说明文档

我们的选题是：A 题--基于市场资金流向分析的商品期货量化交易策略

外部代码工具箱

文件名：libsvm（文件夹）

说明：libsvm 是台湾大学林智仁(Lin Chih-Jen)教授等开发设计的一个简单、易于使用和快速有效的 SVM 模式识别与回归的软件包。

文件名：implement[by faruto]（文件夹）

说明：在 libsvm 的基础上给出相应的辅助函数插件，方便用户来选取最佳的参数。

Matlab 代码文件（.m）

文件名：Plate（文件夹）

说明：处理各个板块的代码

文件名：normalization

说明：对数据进行标准化处理

文件名：static_data_process

说明：静态仿真数据预处理

文件名：dynamic_data_initialization

说明：初始化动态仿真的输入向量和输出向量

文件名：princomp

说明：对基本 K 线数据向量进行主成分分析

文件名：static_simulation

说明：基于基本 K 线数据向量的静态仿真执行代码

文件名：dynamic_simulation

说明：基于基本 K 线数据向量的动态仿真执行代码

文件名: Technical_indicators

说明: 初始化技术指标向量

文件名: Technical_princomp

说明: 对技术指标向量进行主成分分析

文件名: Technical_static_simulation

说明: 基于技术指标向量的静态仿真执行代码

文件名: Technical_dynamic_simulation

说明: 基于技术指标向量的动态仿真执行代码

文件名: RunBackTest

说明: 回测执行代码

文件名: BackTest

说明: 回测代码

文件名: Table_details

说明: 用于设置表格属性

数据包文件 (.mat/.xlsx)

文件名: SHFE

说明: 上海商品期货交易所的所有主力合约交易市场与交易代码

文件名: CZCE

说明: 郑州商品期货交易所的所有主力合约交易市场与交易代码

文件名: DCE

说明: 大连商品期货交易所的所有主力合约交易市场与交易代码

文件名: trend

说明: 记录当天收盘价相对于前一天收盘价的涨跌情况 (0 代表跌或持平、1 代表涨)

文件名: data

说明: K 线基础数据列向合并矩阵

文件名: static_trend

说明: K 线基础数据的输出向量

文件名: K_after_princomp

说明: 对 K 线基础数据进行主成分分析后得到的主成分输入向量

文件名: K_train_result

说明: 对 K 线基础数据的主成分输入向量进行分析交叉验证得到的训练集

文件名: K_test_result

说明: K 线基础数据的测试集

文件名: Technical_data

说明: 技术指标列向合并矩阵

文件名: Correlation

说明: 技术指标向量的相关性矩阵

文件名: Correlation_after_princomp

说明: 技术指标的主成分输入向量

文件名: train_technical

说明: 对技术指标数据的主成分输入向量进行分析交叉验证得到的训练集

文件名: test_technical

说明: 技术指标数据的测试集

文件名: technical_static_trend

说明: 技术指标的输出向量